

2 ETF ĐỀU KHÔNG ĐƯA BID VÀO DANH MỤC KỲ QUÝ III-2015

Theo sau thông báo của ETF VNM ngày 15/9/2015, ETF FTSE VN tiếp tục thông báo sẽ không đưa BID vào danh mục trong kỳ này (Phụ lục 1). BID không được đưa vào danh mục do không đạt tỷ lệ freefloat trên 5% theo quy định chỉ số FTSE. Danh mục tính lại của FTSE VN sau khi không đưa BID vào danh mục và danh mục tổng hợp hoạt động mua bán của 2 quỹ xem chi tiết tại (Phụ lục 2).

Theo số liệu không chính thức, 2 quỹ ETF đã thực hiện mua vào khoảng 9 triệu cổ phiếu BID, trong đó ETF VNM mua vào 6 triệu và FTSE VN mua vào 3 triệu. Do hoạt động mua vào ngoài dự kiến, 2 quỹ sẽ thực hiện bán ra BID trong những phiên tới. Hoạt động thoái vốn từ nay cho đến hết phiên giao dịch 18/9, trong trường hợp không thoái được thì hoạt động thoái vốn còn kéo dài cho đến khi bán hết lượng cổ phiếu BID đã mua vào. Tính toán sai của 2 quỹ ETF đã làm đảo lộn cơ cấu cổ đông BID theo chiều hướng bất lợi khi tăng cổ đông lướt sóng và giảm cổ đông đầu tư dài hạn. Do vậy, khi có thông tin BID không vào danh mục ETF VNM hoạt động bán tháo BID đã xảy ra. Cổ phiếu chỉ khớp lệnh được 130 nghìn cổ phiếu và lượng dư bán sàn gần 8 triệu cổ phiếu trong phiên giao dịch 16/9. Diễn biến biến giá của BID sẽ bất lợi và sẽ diễn biến phức tạp trong những phiên giao dịch tới.

Phụ lục 1: Danh mục ETF FTSE VN cập nhật mới

STT	Mã	Tỷ trọng FTSE VN	Tỷ trọng dự kiến	Tỷ lệ điều chỉnh	Chênh tiền	Số lượng
1	MSN	15.57%	15.0%	-0.6%	(2,073,519)	(569,252)
2	VIC	16.23%	15.0%	-1.2%	(4,395,733)	(2,340,860)
3	HPG	12.14%	12.4%	0.2%	890,034	632,468
4	VCB	10.03%	10.0%	-0.1%	(196,268)	(102,059)
5	SSI	6.42%	6.5%	0.1%	324,302	276,721
6	PVD	6.65%	6.5%	-0.2%	(638,665)	(388,829)
7	STB	6.35%	6.2%	-0.2%	(561,682)	(747,781)
8	HAG	5.51%	5.4%	-0.1%	(333,638)	(498,203)
9	DPM	5.17%	5.1%	-0.1%	(387,804)	(279,168)
10	KDC	3.19%	3.1%	0.0%	(177,508)	(155,671)
11	KBC	2.93%	2.8%	-0.1%	(302,166)	(547,366)
12	BVH	2.83%	2.7%	-0.1%	(372,147)	(176,870)
13	ITA	2.32%	2.3%	-0.1%	(212,839)	(922,304)
14	FLC	1.97%	1.9%	-0.1%	(357,620)	(1,179,614)
15	HVG	1.35%	1.3%	0.0%	(162,538)	(225,918)
16	PDR	0.00%	1.3%	1.3%	4,683,363	6,468,895
17	PVT	1.34%	1.3%	-0.1%	(215,871)	(441,736)
18	TTF	0.00%	1.2%	1.2%	4,493,219	5,946,116

Phụ lục 2: Hoạt động mua bán của 2 ETF khi không đưa BID vào danh mục

STT	MÃ	± Giá trị FTSE	± Giá trị VNM	± Khối lượng FTSE	± Khối lượng VNM	± Tổng Khối lượng
1	BVH	(372,147)	(1,782,363)	(176,870)	(845,284)	(1,022,154)
2	DPM	(387,804)	(1,264,649)	(279,168)	(904,490)	(1,183,658)
3	FLC	(357,620)	83,542	(1,179,614)	279,740	(899,874)
4	HAG	(333,638)	4,118,980	(498,203)	6,150,639	5,652,436
5	HPG	890,034	0	632,468	0	632,468
6	HVG	(162,538)	0	(225,918)	0	(225,918)
7	IJC	0	13,051	0	33,537	33,537
8	ITA	(212,839)	4,926	(922,304)	20,161	(902,143)
9	KBC	(302,166)	425,669	(547,366)	718,114	170,748
10	KDC	(177,508)	1,136,373	(155,671)	1,050,789	895,117
11	MSN	(2,073,519)	(3,140,354)	(569,252)	(913,182)	(1,482,434)
12	TTF	4,493,219	0	5,946,116	0	5,946,116
13	NT2	0	17,239,624	0	16,143,885	16,143,885
14	PPC	0	(153,647)	0	(191,842)	(191,842)
15	PVD	(638,665)	1,100,624	(388,829)	696,957	308,128
16	PVS	0	(352,225)	0	(376,047)	(376,047)
17	PVT	(215,871)	26,995	(441,736)	56,818	(384,918)
18	SHB	0	213,981	0	695,437	695,437
19	STB	(561,682)	594,121	(747,781)	800,614	52,833
20	DRC	0	(3,649,601)	0	(1,683,845)	(1,683,845)
21	VCB	(196,268)	(1,952,112)	(102,059)	(962,984)	(1,065,043)
22	VCG	0	(5,309,356)	0	(10,383,785)	(10,383,785)
23	SSI	324,302	327,558	276,721	290,724	567,445
24	VIC	(4,395,733)	(5,729,024)	(2,340,860)	(3,014,558)	(5,355,418)
25	PDR	4,683,363	0	6,468,895	0	6,468,895